

东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东方阿尔法基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	43
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	43
§ 9 开放式基金份额变动.....	44
§ 10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东方阿尔法瑞利混合发起	
基金主代码	026993	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 04 月 14 日	
基金管理人	东方阿尔法基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	131,166,454.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方阿尔法瑞利混合发起 A	东方阿尔法瑞利混合发起 C
下属分级基金的交易代码	026993	026994
报告期末下属分级基金的份额总额	20,662,213.71 份	110,504,240.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下 11 个方面内容： 1、大类资产配置策略 本基金将根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平阶段性不断调整权益类资产和其他资产之间的大类资产配置比例。 2、股票投资策略 在大类资产配置的基础上，本基金将采用“自下而上”的方式精选个股，结合定性和定量分析对公司投资价值进行评估，在控制风险的基础上创造持续超越业绩比较基准的收益。 3、港股投资策略 本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。 4、存托凭证投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。 5、债券类资产投资策略 本基金将通过研究判断宏观经济趋势、财政和货币政策走向、市场供求和估值变化，合理配置债券类资产，并灵活

	运用久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等投资策略。 6、可转换债券及可交换债券投资策略 本基金将通过对发行人、转股标的公司进行各自行业和基本面分析，再结合市场估值和内嵌条款对其投资价值进行综合判断。 7、资产支持证券投资策略 本基金将通过分析影响资产支持证券定价的多种因素，包括市场利率、发行条款、提前偿还率、支持资产的构成及质量等，评估其内在价值进行投资。 8、股指期货投资策略 本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股指期货的投资。本基金还将利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。 9、国债期货投资策略 本基金以套期保值为主要目的，参与国债期货的投资。本基金还将利用国债期货合约流动性好、交易成本低等特点，通过分析期货合约的风险收益特征对投资组合的利率风险暴露进行及时调整，提高投资组合的运作效率。 10、股票期权投资策略 本基金以套期保值为主要目的参与股票期权交易，利用场内期权合约流动性好、交易成本低等特点，通过分析期权合约的风险收益特征对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。 11、融资业务投资策略 本基金如参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件选择合适的交易对手方。在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中证综合债（全价）指数收益率×20%+恒生指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方阿尔法基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曾健	张姗
	联系电话	0755-21872900	400-61-95555
	电子邮箱	service@dfa66.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-930-6677	400-61-95555
传真		0755-21872902	0755-83195201

注册地址	深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 23BC	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 23BC	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518034	518040
法定代表人	刘明	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.dfa66.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）-2026 年 06 月 30 日）	
	东方阿尔法瑞利混合发起 A	东方阿尔法瑞利混合发起 C
本期已实现收益	-451,954.49	-3,350,519.65
本期利润	6,540,120.70	15,895,231.16
加权平均基金份额本期利润	0.3940	0.2431
本期加权平均净值利润率	33.35%	20.09%
本期基金份额净值增长率	45.23%	45.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-321,325.71	-1,786,674.71
期末可供分配基金份额利润	-0.0156	-0.0162
期末基金资产净值	30,007,497.95	160,397,432.17
期末基金份额净值	1.4523	1.4515
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	45.23%	45.15%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4. 本基金基金合同于 2026 年 04 月 14 日生效，截至 2026 年 06 月 30 日，本基金运作时间未满 1 年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方阿尔法瑞利混合发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	45.23%	3.39%	2.85%	0.90%	42.38%	2.49%

东方阿尔法瑞利混合发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	45.15%	3.39%	2.85%	0.90%	42.30%	2.49%

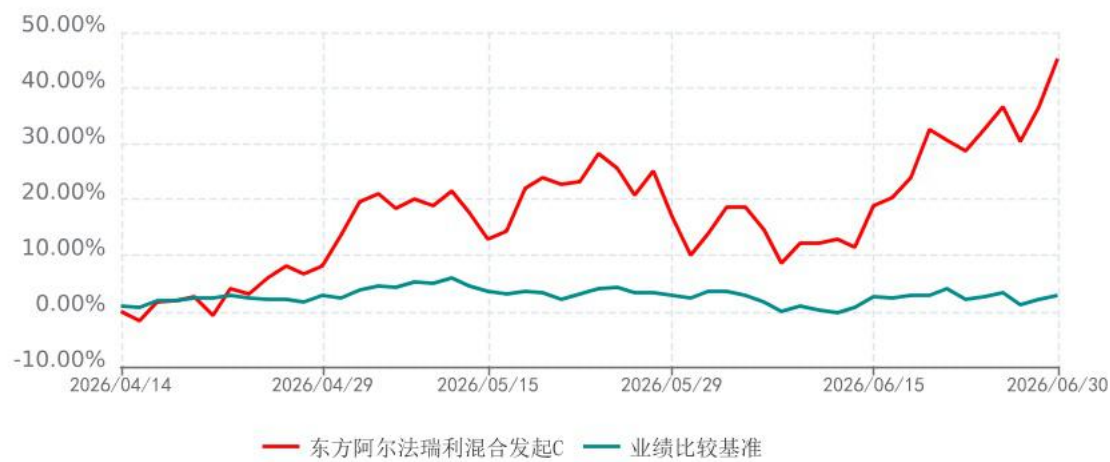
注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中证综合债（全价）指数收益率×20%+恒生指数收益率×20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方阿尔法瑞利混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年04月14日-2026年06月30日)



东方阿尔法瑞利混合发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年04月14日-2026年06月30日)



注：本基金的基金合同于 2026 年 04 月 14 日生效，截至本报告期末，本基金成立未满 1 年。2026 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“东方阿尔法基金”）于 2017 年 6 月 24 日经中国证监会批准，2017 年 7 月 4 日注册成立，公司总部设在广东省深圳市，证券期货业务范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。截至报告期末，注册资本为 1 亿元人民币。

东方阿尔法基金作为华南地区首家纯员工持股的公募基金管理公司，公司股权结构为刘明、珠海共同成长投资合伙企业（有限合伙）、肖冰、曾健分别持有公司 44.46%、39.56%、13.98%、2%的股权。

截至报告期末，东方阿尔法基金管理资产规模 275.33 亿元，旗下管理 15 只公开募集证券投资基金和 3 只私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职日期	离任日期		
孙振波	基金经理	2026-04-14	-	7 年	孙振波先生，中国科学技术大

					学理学学士，复旦大学理学硕士。于 2019 年 6 月入职东方阿尔法基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任东方阿尔法基金管理有限公司基金经理。
梁少文	基金经理	2026-05-11	-	5 年	梁少文先生，华中科技大学工学学士，华中科技大学金融硕士，于 2021 年 11 月入职东方阿尔法基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任东方阿尔法基金管理有限公司基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公告确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指公告确定的任职日期和离任日期。

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本报告期内，本基金管理人利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗（包括当日、3 日内、5 日内）对基金管理人管理的不同投资组合反向交易和同向交易的交易价差监控进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内 GDP 增速达 4.7%，宏观经济整体维持稳健增长态势。全球层面，地缘冲突持续为全球经济及资本市场运行带来不确定性，国际油价年内呈现先涨后跌的走势，阶段性通胀扰动对全球货币政策形成一定冲击，A 股市场也随之出现阶段性波动。整体来看，上半年中东地缘政治冲突经历爆发、缓解的过程。进入 2026 年 7 月，科技板块出现明显情绪波动，行业短期调整压力显现，但截至本报告出具日科技板块已逐步走出调整、呈现止跌反弹态势。在外部环境不确定性抬升的背景下，人工智能产业迭代进程如火如荼，技术落地场景持续丰富，成为科技板块核心增长主线，持续催生结构性投资机会。

从产业基本面与行业景气演变来看，上半年国产算力板块依托 AI 产业高速扩容、海外技术出口限制、国产化替代加速的三重核心逻辑，行业景气度持续抬升，中长期成长确定性相对突出。国内 AI 大模型技术快速迭代，与海外头部模型的技术差距持续收窄，带动下游 AI 数据中心建设需求集中释放，国内高端算力需求稳步高增。与此同时，海外对高端 GPU 出口实施严格限制，国内无法正常采购海外顶尖算力芯片，行业发展痛点持续倒逼算力产业链自主可控进程提速，国产算力领域迎来景气度上行、国产化率提升的双重发展机遇，行业中长期成长逻辑清晰、业绩兑现路径相对明确。

本基金于 2026 年 4 月成立，报告期内紧跟 AI 产业发展趋势，聚焦国产算力领域稳步开展建仓布局。结合行业景气改善、国产替代持续加速的产业趋势，把握二季度行业景气上行的窗口期，重点布局国产 GPU 及整体国产算力产业链。投资过程中，紧密跟踪行业供需格局优化、技术迭代落地、订单业绩释放的节奏，优选技术积淀深厚、产能储备充裕、下游订单确定性较高的优质企业，始终立足产业基本面进行布局，赚取行业稳步发展带来的稳健投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东方阿尔法瑞利混合发起 A 基金份额净值为 1.4523 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 45.23%，同期业绩比较基准收益率为 2.85%；截至报告期末东方阿尔法瑞利混合发起 C 基金份额净值为 1.4515 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 45.15%，同期业绩比较基准收益率为 2.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们认为中国经济具有较强的韧性，中国的产业链优势在动荡的全球格局中具备较强的竞争力，而其中扎根在 AI 产业链的公司将持续受益于 AI 的发展，且相关的股票目前的估值已经具备很好的吸引力，因此我们对股票市场的长期表现持乐观态度。

我们认为国产算力方向具有好的投资机会。一方面，头部大模型厂商和云厂商的需求旺盛，国产 GPU 的性能能满足客户对推理和部分训练场景的需求，国产 GPU 处于供不应求的卖方市场；另一

方面，国产 GPU 供应链的卡点逐步打通，供应端进入加速释放的阶段，相应的业绩也会随着供应增加而快速增长。

基于以上分析，本基金持续关注国产算力链条，把握国产算力的投资机会，力争为基金持有人把握行业中长期成长红利、创造稳健投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人已将本基金的基金估值核算业务外包给本基金的金融运营服务机构—招商证券股份有限公司。本基金金融运营服务机构按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金金融运营服务机构使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。金融运营服务机构改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人建立了估值小组，成员由运作保障部、投资部门、研究部和监察稽核部业务骨干组成，负责指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并

根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	11,537,701.84
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	187,543,644.59
其中：股票投资		177,318,235.39
基金投资		-
债券投资		10,225,409.20
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		4,587,242.09
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		203,668,588.52
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
负 债：		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		1.53
应付赎回款		13,018,178.51
应付管理人报酬		165,862.51
应付托管费		27,643.74
应付销售服务费		35,109.80
应付投资顾问费		-
应交税费		280.23
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	16,582.08
负债合计		13,263,658.40
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	131,166,454.31
未分配利润	6.4.7.8	59,238,475.81
净资产合计		190,404,930.12
负债和净资产总计		203,668,588.52

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，东方阿尔法瑞利混合发起 A 类基金份额净值 1.4523 元，东方阿尔法瑞利混合发起 C 类基金份额净值 1.4515 元，基金份额总额 131,166,454.31 份，其中东方阿尔法瑞利混合发起 A 类基金份额 20,662,213.71 份，东方阿尔法瑞利混合发起 C 类基金份额 110,504,240.60 份。

2、本基金合同生效日为 2026 年 04 月 14 日，本报告期实际报告期间为 2026 年 04 月 14 日至 2026 年 06 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同 生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		22,790,675.35
1. 利息收入		1,441.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,441.39
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,430,679.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,468,115.34
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	9,627.75
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	27,808.52
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	26,237,826.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,982,087.03
减：二、营业总支出		355,323.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	246,958.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	41,159.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	49,353.12
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		43.75
8. 其他费用	6.4.7.19	17,808.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,435,351.86
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,435,351.86
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		22,435,351.86

注：本基金合同生效日为 2026 年 04 月 14 日，本报告期实际报告期间为 2026 年 04 月 14 日至 2026 年 06 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	10,423,051.21	-	10,423,051.21

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	120,743,403.10	59,238,475.81	179,981,878.91
(一)、综合收益总额	-	22,435,351.86	22,435,351.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	120,743,403.10	36,803,123.95	157,546,527.05
其中：1. 基金申购款	288,520,856.45	69,684,921.60	358,205,778.05
2. 基金赎回款	-167,777,453.35	-32,881,797.65	-200,659,251.00
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	131,166,454.31	59,238,475.81	190,404,930.12

注：本基金合同生效日为 2026 年 04 月 14 日，本报告期实际报告期间为 2026 年 04 月 14 日至 2026 年 06 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘明	曹渊	张珂
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2026]405号《关于准予东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由东方阿尔法基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币10,422,657.44元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2026]200Z0083号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同》于2026年4月14日正式生效,基金合同生效日的基金总份额为10,423,051.21份基金份额,其中认购资金利息折合393.77份基金份额。本基金的基金管理人为东方阿尔法基金管理有限公司,基金金融运营服务机构为招商证券股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,388.88份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同》和《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金招募说明书》(含更新),本基金根据所收取的认购/申购费用、销售服务费用等方式的差异,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购/申购费用而不计提销售

服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额，其中，通过基金管理人认购、申购 A 类基金份额的不收取认购、申购费用；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额，其中，通过基金管理人认购、申购 C 类基金份额的不收取销售服务费；通过代销机构认购、申购并持续持有期限超过一年的 C 类基金份额，不再继续收取销售服务费。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中对港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）的投资比例不超过股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中证综合债（全价）指数收益率×20%+恒生指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

a. 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

b. 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

2) 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该

限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。

若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
 - (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
 - (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。
- 如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	1,085,633.69
等于：本金	1,085,528.19
加：应计利息	105.50
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	10,452,068.15
等于：本金	10,451,936.34
加：应计利息	131.81
减：坏账准备	-
合计	11,537,701.84

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		151,084,129.05	-	177,318,235.39	26,234,106.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,195,240.34	26,449.20	10,225,409.20	3,719.66
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,195,240.34	26,449.20	10,225,409.20	3,719.66
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		161,279,369.39	26,449.20	187,543,644.59	26,237,826.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	16,582.08
合计	16,582.08

6.4.7.7 实收基金

东方阿尔法瑞利混合发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,169,541.21	10,169,541.21
本期申购	20,815,547.49	20,815,547.49
本期赎回（以“-”号填列）	-10,322,874.99	-10,322,874.99
本期末	20,662,213.71	20,662,213.71

东方阿尔法瑞利混合发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
----	---

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	253,510.00	253,510.00
本期申购	267,705,308.96	267,705,308.96
本期赎回（以“-”号填列）	-157,454,578.36	-157,454,578.36
本期末	110,504,240.60	110,504,240.60

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2026 年 4 月 10 日至 2026 年 4 月 10 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 10,422,657.44 元，折合为 10,422,657.44 份基金份额(其中 A 类基金份额 10,169,147.44 份，C 类基金份额 253,510.00 份)。根据《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 393.77 元在本基金成立后，折合为 393.77 份基金份额(其中 A 类基金份额 393.77 份，C 类基金份额 0.00 份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同》、《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金招募说明书》及《东方阿尔法增利债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》的相关规定，本基金于 2026 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2026 年 4 月 22 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自 2026 年 4 月 23 日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

东方阿尔法瑞利混合发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-451,954.49	6,992,075.19	6,540,120.70
本期基金份额交易产生的变动数	130,628.78	2,674,534.76	2,805,163.54
其中：基金申购款	44,436.77	4,833,254.05	4,877,690.82
基金赎回款	86,192.01	-2,158,719.29	-2,072,527.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-321,325.71	9,666,609.95	9,345,284.24

东方阿尔法瑞利混合发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-3,350,519.65	19,245,750.81	15,895,231.16
本期基金份额交易产生的变动数	1,563,844.94	32,434,115.47	33,997,960.41
其中：基金申购款	720,902.23	64,086,328.55	64,807,230.78
基金赎回款	842,942.71	-31,652,213.08	-30,809,270.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,786,674.71	51,679,866.28	49,893,191.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	530.92
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	910.47
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,441.39

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	110,003,664.29
减：卖出股票成本总额	115,215,743.59
减：交易费用	256,036.04
买卖股票差价收入	-5,468,115.34

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,153.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,526.19
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,627.75

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,502,172.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,496,899.66
减：应计利息总额	4,356.17
减：交易费用	3,442.53
买卖债券差价收入	-2,526.19

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	27,808.52
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	27,808.52

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	26,237,826.00
——股票投资	26,234,106.34
——债券投资	3,719.66
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-

合计	26,237,826.00
----	---------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,967,745.95
转换费收入	14,341.08
合计	1,982,087.03

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	1,696.56
信息披露费	14,885.52
证券出借违约金	-
汇划手续费	25.00
开户费	1,200.00
证券组合费	1.53
合计	17,808.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方阿尔法基金管理有限公司（“东方阿尔法基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
珠海共同成长投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
刘明	基金管理人的股东

肖冰	基金管理人的股东
曾健	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	246,958.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	107,745.29
应支付基金管理人的净管理费	139,213.03

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

2、本基金的基金合同于 2026 年 04 月 14 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
----	--

当期发生的基金应支付的托管费	41,159.69
----------------	-----------

注：1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

2、本基金的基金合同于 2026 年 04 月 14 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未发生应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金的基金合同于 2026 年 04 月 14 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

东方阿尔法瑞利混合发起 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
刘明	10,000,388.88	48.40%

注：1. 以上表中“持有的基金份额占基金总份额的比例”的计算中，对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2. 上述关联方投资本基金适用的认购、申购、赎回费率按照本基金招募说明书的费率执行。

3. 报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资“东方阿尔法瑞利混合发起 C”。

4. 本基金的基金合同于 2026 年 4 月 14 日生效，无上年末数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 04 月 14 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,085,633.69	530.92

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。本基金的基金合同于 2026 年 04 月 14 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和交易所回购等。本基金在日常投

资产管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的三级风险防控体系。一级风险防范指基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。二级风险防范指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。公司经理层设投资决策委员会，对涉及基金投资的重大问题进行决策，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性目的。监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门，对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。本基金在交易所进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金目前暂未开展银行间同业市场业务，无此类信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察稽核部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监察稽核部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2026 年 06 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2026 年 06 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	11,537,70 1.84	-	-	-	-	-	11,537,70 1.84
交易性金融 资产	-	-	10,225,40 9.20	-	-	177,318,2 35.39	187,543,6 44.59
应收申购 款	-	-	-	-	-	4,587,242 .09	4,587,242 .09
资产总计	11,537,70 1.84	-	10,225,40 9.20	-	-	181,905,4 77.48	203,668,5 88.52
负债							
应付清算 款	-	-	-	-	-	1.53	1.53
应付赎回 款	-	-	-	-	-	13,018,17 8.51	13,018,17 8.51
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	165,862.5 1	165,862.5 1
应付托管 费	-	-	-	-	-	27,643.74	27,643.74
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	35,109.80	35,109.80
应交税费	-	-	-	-	-	280.23	280.23

其他负债	-	-	-	-	-	16,582.08	16,582.08
负债总计	-	-	-	-	-	13,263,658.40	13,263,658.40
利率敏感度缺口	11,537,701.84	-	10,225,409.20	-	-	168,641,819.08	190,404,930.12

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.37%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	11,809,083.74	-	11,809,083.74
资产合计	-	11,809,083.74	-	11,809,083.74
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,809,083.74	-	11,809,083.74

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026 年 06 月 30 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	590,454.19
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-590,454.19

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场

整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中对港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）的投资比例不超过股票资产的 50%。本基金以健康产业行业的上市公司股票为主要投资对象，投资于健康产业相关行业上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	177,318,235.39	93.13
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	177,318,235.39	93.13

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 2026 年 06 月 30 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	17,291,095.18
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-17,291,095.18

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	177,318,235.39
第二层次	10,225,409.20
第三层次	-
合计	187,543,644.59

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	177,318,235.39	87.06
	其中：股票	177,318,235.39	87.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,225,409.20	5.02
	其中：债券	10,225,409.20	5.02
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,537,701.84	5.66
8	其他各项资产	4,587,242.09	2.25
9	合计	203,668,588.52	100.00

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值合计 11,809,083.74 元，占基金资产净值的比例为 6.20%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,973,583.71	51.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,561,241.94	33.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,974,326.00	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	165,509,151.65	86.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	11,809,083.74	6.20
合计	11,809,083.74	6.20

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	688702	盛科通信	44,448	17,334,275.52	9.10
2	688256	寒武纪	10,093	16,103,886.15	8.46
3	688521	芯原股份	42,919	15,928,957.66	8.37
4	688041	海光信息	42,143	15,605,552.90	8.20
5	688802	沐曦股份	15,981	13,237,062.30	6.95
6	688795	摩尔线程	17,583	12,598,043.67	6.62
7	688629	华丰科技	62,716	11,759,877.16	6.18
8	002281	光迅科技	41,600	10,688,704.00	5.61
9	000988	华工科技	53,088	9,800,575.68	5.15
10	688691	灿芯股份	78,263	9,073,029.59	4.77
11	688347	华虹宏力	25,998	8,743,127.40	4.59
12	002897	意华股份	94,700	8,331,706.00	4.38
13	09903	天数智芯	11,500	7,631,080.30	4.01
14	688220	翱捷科技	42,630	5,299,761.60	2.78
15	06082	壁仞科技	78,600	4,178,003.44	2.19
16	688372	伟测科技	15,991	2,974,326.00	1.56
17	300671	富满微	26,800	2,309,088.00	1.21
18	688141	杰华特	12,737	1,955,129.50	1.03
19	688403	汇成股份	48,090	1,909,173.00	1.00
20	688368	晶丰明源	8,576	1,856,875.52	0.98

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	688702	盛科通信	22,976,641.13	12.07
2	688521	芯原股份	21,491,116.71	11.29
3	688041	海光信息	20,650,042.40	10.85
4	688802	沐曦股份	19,056,130.51	10.01
5	688256	寒武纪	18,812,638.24	9.88
6	688795	摩尔线程	18,359,878.92	9.64
7	688220	翱捷科技	16,315,522.06	8.57
8	688691	灿芯股份	15,220,146.70	7.99
9	002281	光迅科技	14,700,654.00	7.72
10	688629	华丰科技	14,088,683.98	7.40
11	000988	华工科技	14,033,964.24	7.37

12	688981	中芯国际	10,865,042.40	5.71
13	002025	航天电器	10,633,490.00	5.58
14	002897	意华股份	8,823,052.50	4.63
15	09903	天数智芯	8,151,175.02	4.28
16	688347	华虹宏力	6,804,053.35	3.57
17	000066	中国长城	4,491,497.00	2.36
18	06082	壁仞科技	4,308,451.59	2.26
19	688372	伟测科技	2,898,201.24	1.52
20	300671	富满微	1,783,860.00	0.94

注：“买入”包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	688220	翱捷科技	10,303,158.51	5.41
2	688521	芯原股份	10,054,796.77	5.28
3	688981	中芯国际	9,556,463.96	5.02
4	688702	盛科通信	9,458,422.85	4.97
5	002025	航天电器	9,258,527.00	4.86
6	688802	沐曦股份	7,463,604.65	3.92
7	688041	海光信息	7,182,432.84	3.77
8	002281	光迅科技	6,578,611.64	3.46
9	688256	寒武纪	6,044,366.16	3.17
10	688795	摩尔线程	5,805,574.69	3.05
11	688629	华丰科技	5,590,996.92	2.94
12	000988	华工科技	5,520,698.00	2.90
13	688691	灿芯股份	4,741,096.38	2.49
14	000066	中国长城	4,055,119.00	2.13
15	603353	和顺石油	1,255,596.00	0.66
16	300857	协创数据	1,235,217.60	0.65
17	301396	宏景科技	1,130,503.00	0.59
18	002290	禾盛新材	1,036,729.00	0.54
19	688347	华虹宏力	979,524.27	0.51
20	300166	东方国信	864,003.00	0.45

注：“卖出”包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	266,299,872.64
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	110,003,664.29
--------------	----------------

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,225,409.20	5.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,225,409.20	5.37

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019835	26 国债 09	85,000	8,513,988.90	4.47
2	019827	26 国债 01	16,000	1,610,371.07	0.85
3	019792	25 国债 19	1,000	101,049.23	0.05

注：截止至报告期末，本基金仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未参与股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,587,242.09
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,587,242.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东方阿尔法瑞利混合发起 A	1,962	10,531.20	0.00	0.00%	20,662,213.71	100.00%
东方阿尔法瑞利混合发起 C	23,675	4,667.55	0.00	0.00%	110,504,240.60	100.00%
合计	25,637	5,116.29	0.00	0.00%	131,166,454.31	100.00%

注：本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属不同类别的基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方阿尔法瑞利混合发起 A	10,126,604.44	49.01%
	东方阿尔法瑞利混合发起 C	1,000.00	0.00%
	合计	10,127,604.44	7.72%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方阿尔法瑞利混合发起 A	>100
	东方阿尔法瑞利混合发起 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	东方阿尔法瑞利混合发起 A	0
	东方阿尔法瑞利混合发起 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占	发起份额总数	发起份额占	发起份额承
----	--------	-------	--------	-------	-------

		基金总份额 比例		基金总份额 比例	诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	10,000,388.88	7.62%	10,000,388.88	7.62%	自合同生效之日起不少于 3 年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,388.88	7.62%	10,000,388.88	7.62%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东方阿尔法瑞利混合发起 A	东方阿尔法瑞利混合发起 C
基金合同生效日（2026 年 04 月 14 日）基金份额总额	10,169,541.21	253,510.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	20,815,547.49	267,705,308.96
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	10,322,874.99	157,454,578.36
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,662,213.71	110,504,240.60

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人高级管理人员、本基金基金经理等相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华宝证券	3	376,303,536.93	100.00%	167,024.35	100.00%	-

注：

1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。本报告期内本基金与证券经纪商不存在关联方关系。

2、本基金管理人负责选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。证券公司的选择标准如下：

1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉，遵守国家及证券监督机构各项法律法规、监管规定；

2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商结算模式进行证券交易和结算的需要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持;

4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时,且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券商结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

3、基金专用交易单元的选择程序如下:

- 1) 选择的证券公司应符合公司规章制度的基本条件;
- 2) 中央交易室征求投研部门及运作保障部意见,筛选候选证券公司,并提交投委会审定;
- 3) 中央交易室负责与选定的证券公司签订经纪服务协议,运作保障部和监察稽核部协助对合同进行审核,确保条款严谨且符合合规要求;
- 4) 经纪服务协议签订后,由中央交易室与证券公司完成开户,并与运作保障部共同完成与证券公司的系统对接、参数设置等交易准备工作,确保系统稳定性和交易流程顺畅。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况:新增华宝证券深圳交易单元 1 个、上海交易单元 1 个、北京交易单元 1 个。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:无。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华宝证券	17,212,599.07	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-07
2	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金托管协议	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-07
3	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金招募说明书	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-07

4	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（A 类份额/C 类份额）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-07
5	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊	2026-04-07
6	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊	2026-04-07
7	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊	2026-04-15
8	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊	2026-04-21
9	东方阿尔法基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
10	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊	2026-05-08
11	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金增聘基金经理的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证监会规定报刊	2026-05-12
12	东方阿尔法基金管理有限公司关于东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定报刊	2026-05-12
13	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金招募说明书更新（2026 年第 1 期）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-12
14	东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（2026 年第 1 期）（A 类份额/C 类份额）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-12

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2026 年 04 月 14 日 -2026 年 05 月 20 日	10,000,388.88	-	-	10,000,388.88	7.62%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响。 2、持有基金份额占比较高的投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响。 3、单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会导致基金仓位调整困难，发生流动性风险。 4、持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权。 5、超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准的东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金招募说明书》（含更新）；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司，客户服务电话：400-930-6677（免长途话费）。
- 3、投资者可通过中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）和基金管理人网站（<https://www.dfa66.com>）查阅本报告书。

东方阿尔法基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日